

工行金融市场：外币汇率市场上周概览

(2016 年 11 月 28 日-12 月 2 日)

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周下跌 0.71%，上周最高 101.83、最低 100.62，收于 100.77。美元指数上周呈现震荡走势。上周一（11 月 28 日），因投资者利用美债收益率从近期高位小幅回落的机会，对美元涨势进行整固，美元对主要货币基本持稳。上周二（11 月 29 日），跟随美债收益率的跌势，美元指数下跌。上周三（11 月 30 日），因油价上涨推升美国国债收益率，且美国民间就业数据强劲，提振市场对美联储明年将秉持鹰派立场的预期，美元指数上涨。上周四（12 月 1 日），因外汇交易商在美元大涨后锁定利润，且市场在非农报告出炉前保持谨慎态度，美元指数下跌。上周五（12 月 2 日），美国非农就业报告数据稳健但不够靓丽，令投资者对明年美国加息路径产生了疑虑，美元指数继续下跌，收于 100.77。预计本周阻力位 101.98，支撑位 99.56。
- 欧元兑美元较前周上涨 0.81%，上周最高 1.0689、最低 1.0551，收于 1.0670。欧元兑美元上周呈现震荡走势。上周前两个交易日，美元指数从高点回落，且受助于法国前总理菲永在法国

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。

右翼总统初选中的胜利，欧元兑美元上涨。上周三，美元指数上涨，且意大利修宪公投临近导致欧元区不稳定因素增加，欧元兑美元下跌。上周四，受石油输出国组织（OPEC）达成限产协议支撑油价上涨的影响，欧元兑美元上升。上周五，美元指数在美国非农就业报告公布前趋疲，欧元兑美元守住涨势，收于 1.0670。预计本周阻力位 1.0808，支撑位 1.0532。

- 美元兑日元较前周上涨 0.42%，上周最高 114.82、最低 111.32，收于 113.54。美元兑日元上周呈震荡上行走势。上周一，跟随美债收益率从高点回落的走势，美元兑日元下降。上周二，受美国公布的良好经济数据提振，美国国债收益率结束三天跌势、恢复上升，美元兑日元上涨。上周三，石油输出国组织（OPEC）达成限产协议，推升油价上涨，美国国债收益率上升，而美国民间就业数据强劲提振美联储明年将持鹰派立场的预期，美元兑日元上涨。上周最后两个交易日，市场在美国非农就业数据前保持谨慎态度，且数据公布后不够亮眼，令投资者对明年美联储的加息路径产生疑虑，受此影响，美元指数下挫，美元兑日元下跌，收于 113.54。预计本周阻力位 117.04，支撑位 110.04。

- 澳元兑美元较前周上涨 0.40%，上周最高 0.7497、最低 0.7366，收于 0.7460。澳元兑美元呈震荡走势。上周前两个交易日，

因大宗商品价格上涨及澳元债券收益率相对较高，增强了套利

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。

交易活跃度，澳元兑美元上扬。上周三，澳洲建筑许可数据意外疲弱，铁矿石价格修正，澳元兑美元失去上涨动能，转为下跌。上周四，澳洲公布的第三季企业资本支出较前季意外减少4%，降幅超过预期的2.5%，数据公布后澳元兑美元短暂下跌，但很快反弹，因市场仍坚持对澳元利率前景的看法，澳元兑美元表现出韧性。上周五，受坚挺的大宗商品价格和澳元兑日元利差交易需求支撑，澳元兑美元上升，收于0.7460。预计本周阻力位0.7591，支撑位0.7329。

表 1：国际外汇市场主要货币汇率变动

主要货币汇率	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
美元指数	100.77	-0.71%	-0.72%
欧元/美元	1.0670	0.81%	0.80%
美元/日元	113.54	0.42%	-0.79%
澳元/美元	0.7460	0.40%	1.06%

数据来源：路透

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。